

Disclosure on asset encumbrance

Template A Vermögenswerte		Buchwert belasteter Vermögenswerte	Beizulegender Zeitwert belasteter Vermögenswerte	Buchwert unbelasteter Vermögenswerte	Beizulegender Zeitwert belasteter Vermögenswerte
010	Summe Vermögenswerte	5.816.026.434,83		7.941.549.867,17	
020	Jederzeit kündbare Darlehen	0,00		562.403.900,00	
030	Eigenkapitalinstrumente	0,00	0,00	27.673.760,00	42.754.249,73
040	Schuldverschreibungen	1.119.674.825,70	1.127.280.043,83	1.722.050.829,30	1.736.817.847,51
100	Darlehen und Kredite außer jederzeit kündbaren Darlehen	4.519.150.276,97		5.266.001.586,03	
120	Sonstige Vermögenswerte	177.201.332,16		363.419.791,84	

Template B Entgegengenommene Sicherheiten		Beizulegender Zeitwert entgegengenommener belasteter Sicherheiten oder begebener eigener Schuldverschreibungen	Beizulegender Zeitwert entgegengenommener Sicherheiten oder begebener, zur Belastung verfügbarer eigener Schuldverschreibungen
130	Summe entgegengenommene Sicherheiten	0,00	0,00
140	Jederzeit kündbare Darlehen	0,00	0,00
150	Eigenkapitalinstrumente	0,00	0,00
160	Schuldverschreibungen	0,00	0,00
220	Darlehen und Kredite außer jederzeit kündbaren Darlehen	0,00	0,00
230	Sonstige entgegengenommene Sicherheiten	0,00	0,00
240	Begebene eigene Schuldverschreibungen außer eigenen gedeckten Schuldverschreibungen oder forderungsunterlegten Wertpapieren	0,00	2.745.029,88

Template C Belastungsquellen		Kongruente Verbindlichkeiten, Eventualverbindlichkeiten oder verliehene Wertpapiere	Vermögenswerte, entgegengenommene Sicherheiten und begebene eigene Schuldverschreibungen außer gedeckten Schuldverschreibungen und belasteten, forderungsunterlegten Wertpapieren.
010	Buchwert ausgewählter finanzieller Verbindlichkeiten	2.894.092.977,59	5.790.030.270,47

D - Informationen

Die Daten sind per 31.12.2018. Die wichtigste Belastungsquelle sind begebene Pfandbriefe, wobei ein signifikanter Teil des Deckungsstocks nicht belastet ist. Von den sonstigen Vermögensgegenständen kann ein signifikanter Teil nicht verpfändet werden. Im Derivatebereich bestehen erhaltene und gelieferte Besicherungen ganz überwiegend aus Bareinlagen. Nur im geringen Ausmaß werden Wertpapiere als Sicherheiten verwendet. Die Bank ist im Collateralbereich momentan überwiegend Sicherheitengeberin. Das heißt, dass die barwertigen Verbindlichkeiten aus Derivatgeschäften überwiegend barbesichert wurden. Belastungen bestehen nur bei der Bank, nicht in den Töchtern.